富国天盛灵活配置混合型证券投资基金

[2014] 半年度报告摘要

基金管理人：	富国基金管理有限公司
基金托管人：	中国农业银行股份有限公司
送出日期：	2014年08月28日

§1 重要提示及目录

1.1重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

自2014年4月30日汉盛证券投资基金终止上市日起，原汉盛证券投资基金转型为富国天盛灵活配置混合型证券投资基金。原汉盛证券投资基金报告期为2014年1月1日至2014年4月29日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金报告期为2014年4月30日至2014年6月30日。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

2.1.1转型前基金（原汉盛证券投资基金）基本情况

基金简称	富国汉盛封闭
场内简称	基金汉盛
基金主代码	500005
交易代码	500005
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年05月10日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999年5月18日

2.1.2转型后基金（富国天盛灵活配置混合型证券投资基金）基本情况

基金简称	富国天盛灵活配置混合
场内简称	–
基金主代码	000634
交易代码	前端交易代码：000634 后端交易代码：000635
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年04月30日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,653,976,030.52份
基金合同存续期	不定期。

2.2基金产品说明

2.2.1转型前基金（原汉盛证券投资基金）产品说明

投资目标	为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	“精选品种、组合投资、长线持有、波段操作”，通过研究和发掘具有良好发展前景的上市公司进行组合投资。长期投资为主轴，同时依据“顺势而为”的原则进行一些短线操作。
业绩比较基准	无。
风险收益特征	无。

2.2.2转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金产品说明

投资目标	本基金力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券选择，实现基金资产较高的长期回报。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析和定量分析贯穿与资产配置，行业细分，公司价值评估以及组合风险管理多过程中。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%.
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	李芳菲
	联系电话	021-20361818	010—66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		95105686，4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼 中国农业银行 北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	转型前（2014年1月1日至2014年4月29日）	转型后（2014年4月30日（基金转型日）至2014年6月30日）
本期已实现收益	-28,946,619.18	12,916,339.07
本期利润	-69,784,396.96	95,511,820.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0349	0.0525
本期基金份额净值增长率	-3.35%	6.77%
3.1.2期末数据和指标	转型前（2014年4月29日）	转型后（2014年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.0081	0.0187
期末基金资产净值	2,016,141,643.57	1,740,375,823.65
期末基金份额净值	1.0081	1.052

注：本基金于2014年4月30日转型，新基金合同生效日为2014年4月30日，截至报告期末新基金合同生效不满半年。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2转型前基金汉盛证券投资基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.52%	1.73%	-	-	-	-
过去六个月	-3.35%	2.07%	-	-	-	-
过去一年	2.09%	1.99%	-	-	-	-
过去三年	8.16%	2.02%	-	-	-	-
自基金合同生效日起至今	551.46%	2.55%	-	-	-	-

注：由于基金汉盛在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此表只列示基金的净值表现。

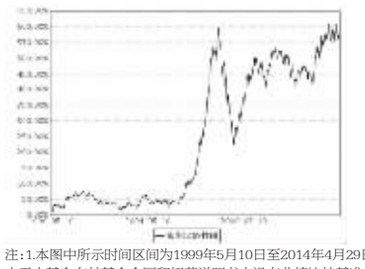
过去三个月为2014年4月1日至2014年4月29日。

过去六个月为2014年1月1日至2014年4月29日。

过去一年为2013年7月1日至2014年4月29日。

过去三年为2011年7月1日至2014年4月29日。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1.本图中所示时间区间为1999年5月10日至2014年4月29日。

由于本基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准，此图只列示基金的净值表现。

2.本基金于1999年5月10日成立，建仓期6个月，从1999年5月10日至1999年11月9日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3转型后基金富国天盛灵活配置混合型证券投资基金净值表现

3.3.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.27%	1.09%	0.53%	0.51%	3.74%	0.58%
自基金合同生效日起至今	6.77%	0.93%	1.05%	0.51%	5.72%	0.42%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映A股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmark）按下列公式计算：

benchmarkt =65%* [沪深300指数t/(沪深300指数t-1)-1] +35%* [中债综合指数t/(中债综合指数t-1)-1]；

其中，t=1，2，3，…，T，T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmark t)]-1

其中，T=2，3，4，…；∏Tt=1(1+benchmark t)表示t日至T日的(1+benchmark t)数学连乘。

3.3.2自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1、本图中所示时间区间为2014年4月30日至2014年6月30日，本基金自基金转型日至图表截止日不足半年。

2、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金由汉盛证券投资基金转型而成。基金转型经2014年3月6日至2014年4月8日汉盛证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案（证券基金机构监管部部函[2014]67号）。自2014年4月30日起，汉盛证券投资基金在上海证券交易所终止上市，其由《汉盛证券投资基金基金合同》修订而成的《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》正式生效。

3、富国基金管理有限公司以2014年6月4日为份额折算基准日对投资者持有的原汉盛证券投资基金进行了基金份额折算操作。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算前基金份额净值为1.015元，精确到小数点后第9位为1.014909401元（第10位舍去），本基金管理人按照1.014909401的折算比例对原汉盛证券投资基金进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为1.000元，折算后的基金份额为折算前的基金份额乘以折算比例，采用循环进位法保留到小数点后两位，折算后基金份额总额为1,834,804,944.82份。

4、本基金于2014年4月30日由原汉盛证券投资基金转型而成，建仓期6个月，截止至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1基金管理人及基金经理

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至2014年6月30日，本基金管理人共管理汉兴证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利回报分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强收益定期开放债券型证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国信用增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业股票型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金四十七只证券投资基金。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）简介

原汉盛证券投资基金：

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁宜	本基金基金经理兼任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-10-12	-	8年	博士，曾任申银万国证券研究所有限公司宏观分析师、高级宏观分析师、高级策略分析师。首席策略分析师；2011年3月至今任富国基金管理有限公司首席经济学家。2011年3月至2012年10月任基金经理助理，2012年10月至2014年4月29日任汉盛证券投资基金基金经理，2013年4月起任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年4月30日起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
戴益强	本基金前任基金经理	2012-10-12	2014-01-13	8年	硕士，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员；2008年9月至2012年10月任富国基金管理有限公司行业研究员，2012年10月至2014年1月任汉盛证券投资基金基金经理，2013年8月起任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理，2014年1月起任汉兴证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
贺轶	本基金前任基金经理	2010-01-13	2014-01-29	13年	硕士，曾任中国银行云南省分行国际业务部银行职员；菲利普证券公司分析员；中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员；中银基金管理有限公司投资部助理副总裁；汇丰晋信基金管理公司投资管理部投资经理，基金经理；富国基金管理有限公司营销策划与产品部高级营销策划经理、权益投资部策略分析师，2010年1月至2014年1月任汉盛证券投资基金基金经理，2012年9月起任富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理，兼任富国基金管理有限公司权益投资副总监。具有基金从业资格。

注：上述表格内基金经理的任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

富国天盛灵活配置混合型证券投资基金：

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁宜	本基金基金经理兼任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014-04-30	-	8年	博士，曾任申银万国证券研究所有限公司宏观分析师、高级宏观分析师、高级策略分析师。首席策略分析师；2011年3月起任富国基金管理有限公司首席经济学家，2011年3月至2012年10月任基金经理助理，2012年10月至2014年4月29日任汉盛证券投资基金基金经理，2013年4月起任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年4月30日起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：上述表格内基金经理的任职日期为本基金转型后的基金合同生效日。

证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

袁宜先生自2012年10月12日起担任汉盛证券投资基金基金经理；2014年4月30日汉盛证券投资基金转型为富国天盛灵活配置混合型证券投资基金，袁宜先生继续担任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司自2014年1月1日至2014年4月29日作为原汉盛证券投资基金的管理人、自2014年4月30日至2014年6月30日作为转型后的富国天盛灵活配置混合型证券投资基金的管理人，分别按照转型前后的《汉盛证券投资基金基金合同》、《富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，并严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2异常交易行为的专项说明

（1）自2014年1月1日至2014年4月29日未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内汉盛证券投资基金与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现14次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

（2）自2014年4月30日至2014年6月30日未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内富国天盛灵活配置混合型证券投资基金与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现4次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，中国经济增速低位徘徊，消费、投资、出口都表现疲弱。在此背景下，3月以来，稳增长的力度有所加强，财政货币政策偏于宽松。

上半年A股市场的表现也基本平稳，波幅几乎创下历史最低。而沪港通、新股发行等事件，曾给市场带来阶段性的冲击。期间，各类主题投资相对活跃。

本基金于2月中旬逐步减仓，一定程度上规避了之后成长股的回调。在4月底完成封转开、5月度过集中申购期以后，本基金逐步加仓，并在半年末保持了相对较高的仓位。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年4月29日，汉盛证券投资基金份额净值为1.0081元。本报告期（2014年1月1日至2014年4月29日）份额净值增长率为-3.35%。

截至2014年6月30日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金份额净值为1.052元，份额累计净值为1.068元。本报告期（2014年4月30日至2014年6月30日）份额净值增长率为6.77%，同期业绩比较基准收益率为1.05%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，在四季度经济同比增速回升以前，流动性环境还将保持对A股有利的宽松格局，随着沪港通兑现的时点临近，低估值的蓝筹板块值得配置。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

2014年1月1日至2014年4月29日，汉盛证券投资基金于2014年3月19日公告对2013年报告期内利润进行收益分配，每10份基金份额派发现金红利2.06元，共计派发现金红利412,000,001.06元。汉盛证券投资基金在本报告期内的利润分配已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

2014年4月30日至2014年6月30日，富国天盛灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

§5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司 2014年1月1日至2014年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 转型前基金（原汉盛证券投资基金）半年度财务报表(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体：汉盛证券投资基金

报告截止日：2014年4月29日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年4月29日	上年度末 (2013年12月31日)
资 产：		
银行存款	180,315,651.58	43,030,384.32
结算备付金	12,459,802.02	27,355,569.61
存出保证金	1,972,773.43	3,123,524.39
交易性金融资产	1,818,273,790.43	2,229,595,717.79
其中：股票投资	1,007,692,357.13	1,587,339,546.39
基金投资	-	-
债券投资	810,581,433.30	642,256,171.40
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	175,600,000.00
应收证券清算款	3,055,795.96	23,565,225.76
应收利息	15,973,458.90	8,573,880.13
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	24.36
资产总计	2,032,051,272.32	2,510,844,326.36
负债和所有者权益	本期末 2014年4月29日	上年度末 (2013年12月31日)
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	10,528,810.69	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,463,791.05	3,186,064.30
应付托管费	410,631.85	531,010.73
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	527,426.72	7,130,651.02
应交税费	1,478,558.72	1,478,558.72
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	500,409.72	592,000.00
负债合计	15,909,628.75	12,918,284.77
所有者权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	16,141,643.57	497,926,041.59
所有者权益合计	2,016,141,643.57	2,497,926,041.59
负债和所有者权益总计	2,032,051,272.32	2,510,844,326.36

注：报告截止日2014年04月29日（基金合同终止日），基金份额净值1.0081元，基金份额总额2,000,000,000.00份。

6.2利润表

会计主体：汉盛证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年4月29日

单位：人民币元

项 目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)
一、收入	-47,191,291.73	308,788,678.87
1.利息收入	10,654,209.60	13,365,321.26
其中：存款利息收入	277,367.52	680,788.38
债券利息收入	9,893,456.45	10,254,077.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	483,385.63	2,430,455.35
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-17,007,723.55	388,609,521.27
其中：股票投资收益	-18,602,445.55	381,835,069.98
基金投资收益	-	-
债券投资收益	741,995.05	-1,130,187.95
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	852,726.95	7,904,639.24
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-40,837,777.78	-93,186,163.66
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减：二、费用	22,593,105.23	43,923,894.54
1.管理人报酬	11,682,183.28	17,599,387.74
2.托管费	1,947,091.25	2,933,231.23
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,508,878.05	23,079,740.49
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	1,454,952.65	311,535.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-69,784,396.96	264,864,784.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-69,784,396.96	264,864,784.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汉盛证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年4月29日

单位：人民币元

项目	本期 (2014年1月1日至2014年4月29日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	497,926,041.59	2,497,926,041.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-69,784,396.96	-69,784,396.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-412,000,001.06	-412,000,001.06
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	16,141,643.57	2,016,141,643.57
项目	上年度可比期间 (2013年01月01日至2013年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	175,911,856.39	2,175,911,856.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	264,864,784.33	264,864,784.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-76,000,000.59	-76,000,000.59
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	364,776,640.13	2,364,776,640.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

陈戈 林志松 雷青松

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

汉盛证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[1999]13号文《关于同意设立汉盛证券投资基金的批复》的核准，由富国基金管理有限公司、海通证券股份有限公司（原名为海通证券有限公司）、中银万国证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司（原名为江苏证券有限责任公司）、山东省国际信托有限公司（原名为山东省国际信托投资公司）、福建省投资开发集团有限责任公司（原名为福建国际信托投资公司）于1999年5月10日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式，存续期为15年，发行规模为20亿份基金份额。本基金经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证上字[99]27号文审核同意，于1999年5月18日在上交所挂牌交易。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为中国境内上市的股票、债券及中国证监会批准的其他金融工具。本基金投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。本基金资产总值80%以上投资于股票、债券市场，其中投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。

6.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2014年1月1日至2014年4月29日的财务状况以及2014年1月1日至2014年4月29日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

6.4.5会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人，基金发起人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人，基金代销机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东，基金代销机构
申银万国证券股份有限公司(“申银万国”)	基金管理人的股东，基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条